



短期市場の推移

	9月29日	9月30日	10月3日	10月4日
加重平均金利	▲0.066	▲0.073	▲0.065	▲0.059
東京レポレート(TN)	▲0.118	▲0.097	▲0.100	▲0.116
無コール残	143,967	102,783	140,224	132,827
ON	78,260	64,030	83,281	71,439
その他	65,707	38,753	56,943	61,388
有コール残	32,493	30,413	30,327	31,975

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの、無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.052	▲0.104
T/N	-	-	-	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.128
2W	-	-	▲0.055	▲0.134
3W	-	-	-	▲0.136
1M	▲0.060	0.480	▲0.042	▲0.139
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	0.163	▲0.144

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

10月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)8月小売売上高 [前月比]	-
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%～▲0.045%の水準で取引された。大手行を中心に積極的に調達を行う先もあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.045

登営業日のマーケット

本日同様にビッドサイドの調達意欲は強く、合出水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月5日	10月6日	10月7日
券	▲100	▲800	▲1,000
財政	▲30,200	+2,600	▲8,000
過不足	▲30,300	+1,800	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
国債買入		+11,300	
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+15,900	+16,100	
当座預金増減	▲29,600	+29,100	▲9,000
当座預金残高	4,850,200	4,879,300	4,870,300
準備預金残高	4,211,300	主な需給要因	
積み終了先	4,210,300	流動性供給	
超過準備	4,210,300		
非準備先残高	638,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	66.7%		
乖離率	33.2%		

10月5日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(10/6~)						
5~10年	261	261				
5~10年	0	0				
国債買入(10/6~)						
~1年	1,500	1,813	1,500	▲0.090	▲0.020	17.6
1~3年	4,750	17,045	4,752	▲0.006	▲0.006	94.2
3~5年	4,750	11,900	4,753	▲0.006	▲0.004	68.0
国債補完供給(10/5~10/6)						
15,952	15,952	▲0.350	▲0.350			
10	10	▲0.350	▲0.350			

マネタリーベース [億円]
10月4日時点 6,129,300

所要	今積期の所要準備額	3,750,600
10月6日以降の残り所要		
積数	1,100	
平均	100	

国庫短期証券入札予定

10月6日	6ヶ月(第1112回)
10月7日	3ヶ月(第1113回)
10月14日	3ヶ月
10月19日	1年

国債入札予定

10月12日	30年
10月14日	5年
10月18日	20年
10月27日	2年

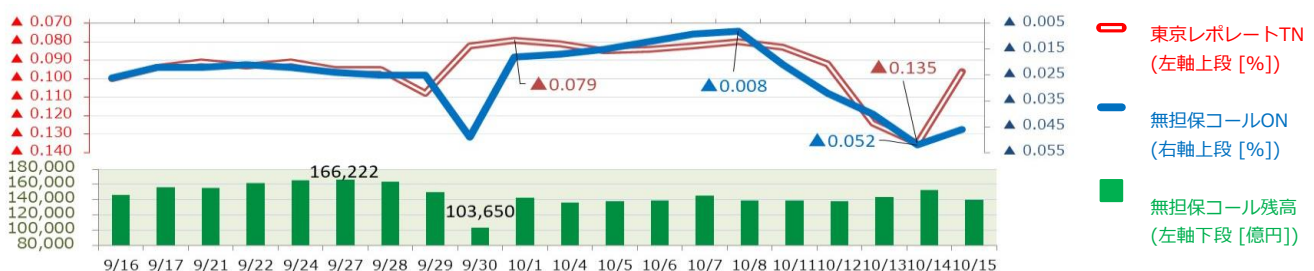
今日の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回	10月5日	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	10月5日	3
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	10月5日	3
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	9月30日	4
10年超25年以下	2500	1,250	11 26	9月30日	2
25年超	1000	500	17 26	9月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	9月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	1

1年前の市場推移

○2021年9月積み期 [9月16日~10月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会